

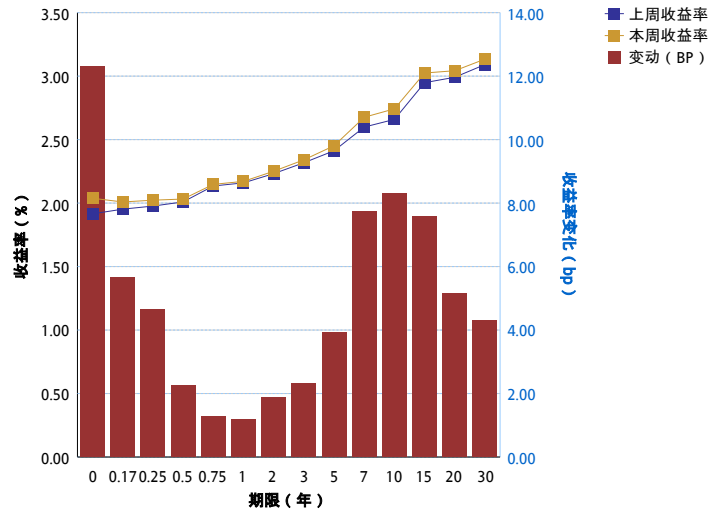
指数20161024--20161031

指数名称	指标名称	20161031	20161024	变化率(%)	上涨点数
中债-央票总指数	净价指数	102.1426	102.1745	-0.03	-0.0319
中债-央票总指数	平均市值法久期	0.0328	0.0377	-13.00	-0.0049
中债-央票总指数	财富指数	154.1835	154.1303	0.03	0.0532
中债-综合指数	净价指数	104.9961	105.2314	-0.22	-0.2353
中债-综合指数	平均市值法久期	4.0993	4.1098	-0.26	-0.0105
中债-综合指数	财富指数	180.7569	181.0069	-0.14	-0.2500

收益率曲线变动情况20161024-20161031

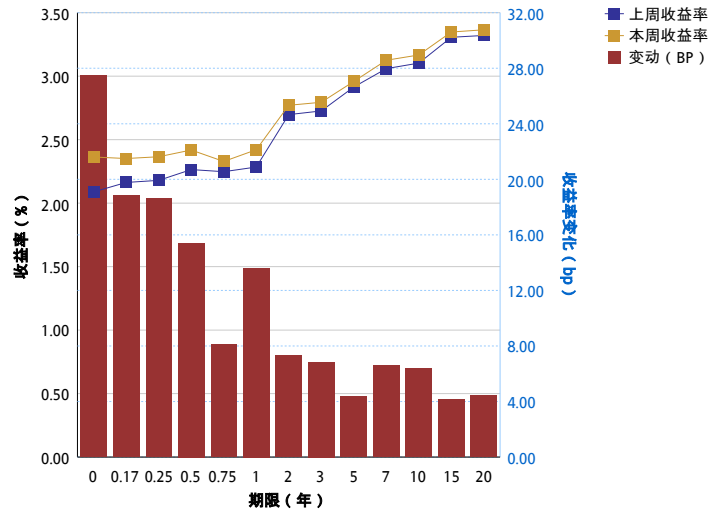
1.中债国债收益率曲线关键期限比较

期限 (年)	20161024	20161031	变动 (bp)
0.00	1.9152	2.0381	12.29
0.17	1.9524	2.0089	5.65
0.25	1.9765	2.0229	4.64
0.50	2.0094	2.0319	2.24
0.75	2.1349	2.1475	1.27
1.00	2.1593	2.1711	1.18
2.00	2.2320	2.2507	1.87
3.00	2.3177	2.3407	2.31
5.00	2.4124	2.4518	3.94
7.00	2.5989	2.6762	7.73
10.00	2.6595	2.7425	8.31
15.00	2.9487	3.0245	7.58
20.00	2.9912	3.0426	5.14
30.00	3.0914	3.1343	4.29
平均	2.3857	2.4346	4.89



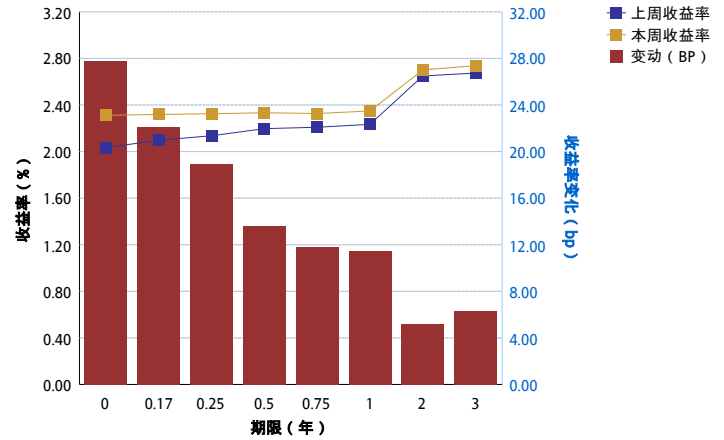
2.政策性银行债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161024	20161031	变动 (bp)
0.00	2.0887	2.3635	27.47
0.17	2.1629	2.3514	18.86
0.25	2.1793	2.3654	18.61
0.50	2.2643	2.4185	15.42
0.75	2.2477	2.3285	8.08
1.00	2.2844	2.4206	13.62
2.00	2.6974	2.7708	7.34
3.00	2.7261	2.7945	6.84
5.00	2.9146	2.9585	4.38
7.00	3.0596	3.1254	6.58
10.00	3.1031	3.1671	6.40
15.00	3.3064	3.3479	4.15
20.00	3.3207	3.3653	4.46
平均	2.6427	2.7521	10.94



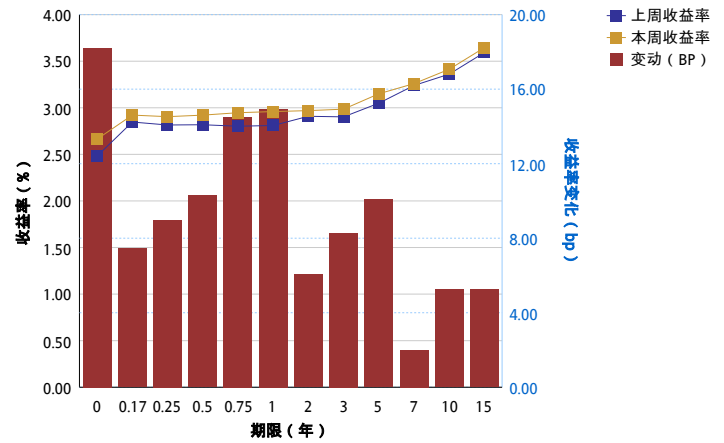
3.央票收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161024	20161031	变动 (bp)
0.00	2.0336	2.3111	27.75
0.17	2.0974	2.3187	22.13
0.25	2.1358	2.3250	18.92
0.50	2.1967	2.3331	13.64
0.75	2.2088	2.3267	11.79
1.00	2.2339	2.3484	11.45
2.00	2.6494	2.7016	5.22
3.00	2.6742	2.7373	6.31
平均	2.2787	2.4252	14.65



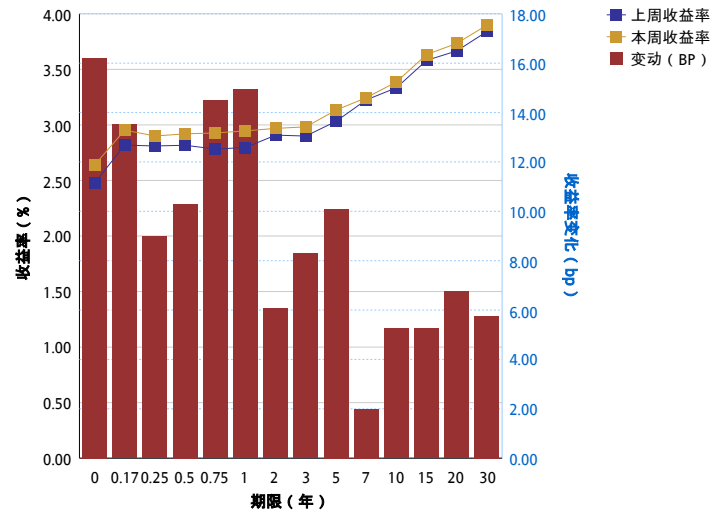
4.AAA中短期票据收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161024	20161031	变动 (bp)
0.00	2.4809	2.6630	18.21
0.17	2.8472	2.9217	7.45
0.25	2.8151	2.9048	8.97
0.50	2.8181	2.9210	10.29
0.75	2.8019	2.9469	14.50
1.00	2.8099	2.9594	14.95
2.00	2.9087	2.9694	6.07
3.00	2.9026	2.9854	8.28
5.00	3.0493	3.1502	10.09
7.00	3.2397	3.2596	1.99
10.00	3.3613	3.4138	5.25
15.00	3.5936	3.6461	5.25
平均	2.9690	3.0618	9.27



5.AAA企业债收益率曲线关键期限点比较

期限 (年)	20161024	20161031	变动 (bp)
0.00	2.4771	2.6392	16.21
0.17	2.8179	2.9531	13.52
0.25	2.8106	2.9003	8.97
0.50	2.8166	2.9195	10.29
0.75	2.7828	2.9278	14.50
1.00	2.7966	2.9460	14.94
2.00	2.9079	2.9687	6.08
3.00	2.8997	2.9825	8.28
5.00	3.0324	3.1333	10.09
7.00	3.2250	3.2450	1.99
10.00	3.3343	3.3868	5.25
15.00	3.5811	3.6336	5.25
20.00	3.6663	3.7338	6.75
30.00	3.8411	3.8986	5.75
平均	3.0707	3.1620	9.13



市场交易概览20161024--20161031

序号	业务类别	本周结算面额 (亿元)	结算面额较上周涨跌幅 (%)	本周笔数	笔数较上周涨跌幅 (%)
1	现券交易	8,539.65	-9.55	11,677	-3.76
2	质押式回购	45,130.36	-7.26	12,374	-10.55
3	买断式回购	2,075.87	-7.72	2,044	-11.78
4	远期交割	-	-	-	-
5	债券借贷	271.80	13.29	133	14.66
汇总		56,017.68	-2.81	26,228	-2.86

现券交易情况20161024--20161031

债券类别	本周结算面额 (亿元)	结算面额较上周涨跌幅 (%)	本周笔数	笔数较上周涨跌幅 (%)
中央企业债	16.30	-79.96	34	0.00
中期票据	80.89	-62.91	151	-25.98
二级资本工具	49.31	-35.81	40	25.00
保险公司金融债	3.00	-28.57	6	-25.00
商业银行债券	50.83	-48.76	49	-30.99
国际机构债券	6.00	0.00	6	0.00
地方企业债	740.95	9.24	1,494	16.63
地方政府债	431.40	-14.64	204	-9.33
扶贫专项金融债	0.10	-96.67	1	-80.00
政府支持机构债	73.40	40.90	82	12.33
政策性银行债券	5,563.35	-9.40	7,434	-4.50
记账式国债	1,494.40	-2.72	2,138	-9.18
资产支持证券	1.00	-37.50	2	-60.00
集合企业债	4.50	-	8	-
非银行金融机构债	14.58	-6.54	14	27.27
项目收益债券	9.64	-56.91	14	-65.00
合计	8,539.65	-28.68	11,677	-15.25

质押式回购交易情况20161024--20161031

交易期限品种	正回购金额 (亿元)	正回购笔数	利率 (最小)	利率 (最大)	利率 (平均)
R01D	25,763.26	6,154	0.0210	0.0540	0.0252
R01M	160.16	69	0.0275	0.0500	0.0348
R02D	107.25	59	0.0240	0.0400	0.0300
R02M	73.95	52	0.0275	0.0450	0.0350
R03D	11,440.22	2,914	0.0210	0.0500	0.0251
R03M	29.22	12	0.0285	0.0335	0.0312
R04M	14.30	3	0.0285	0.0305	0.0292
R06M	9.05	7	0.0310	0.0350	0.0324
R07D	5,834.50	2,334	0.0223	0.0560	0.0329
R09M	1.00	1	0.0345	0.0345	0.0345
R14D	1,379.15	624	0.0245	0.0540	0.0356
R21D	318.31	145	0.0260	0.0530	0.0396
合计	45,130.36	12,374	0.0210	0.0560	0.0321